

# 神宇通信科技股份有限公司

## 2023 年度证券与衍生品投资情况的专项报告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据深圳证券交易所颁布的《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 2 号——创业板上市公司规范运作》《深圳证券交易所创业板上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理》等有关规定的要求，公司董事会对公司 2023 年度证券与衍生品投资情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

### 一、证券与衍生品投资审议批准情况

#### （一）证券投资审议批准情况

2023 年 4 月 13 日，公司第五届董事会第九次会议、第五届监事会第八次会议分别审议通过了《关于使用闲置自有资金进行证券投资的议案》，同意公司在确保不影响公司正常运营的情况下，使用不超过 1 亿元（含本数）的闲置自有资金进行证券投资，用于购买金融机构发行的中低风险的资金类理财产品（如固收+型的非保本浮动收益型理财产品）、进行新股配售或者申购、公开及非公开发行股票（股权）认购、证券（含股票、基金、债券等）的二级市场交易等。上述额度自股东大会审议通过之日起至 2023 年度报告披露之日内有效，在前述额度和期限范围内，可循环滚动使用，并同意授权公司董事长或总经理在上述有效期及资金额度内签署相关合同及文件。2023 年 5 月 8 日，公司 2022 年度股东大会审议通过上述议案。

#### （二）衍生品投资审议批准情况

2023 年 4 月 13 日，公司第五届董事会第九次会议、第五届监事会第八次会议分别审议通过了《关于公司开展期货套期保值业务的议案》，同意公司在确保不影响公司正常运营的情况下，通过境内商品期货交易所期货合约开展铜、

银、锡等金属套期保值业务，持仓保证金额度上限为 1000 万元；任一交易日持有的最高合约价值上限为 1 亿元，并授权公司相关专业人员负责管理。上述额度自股东大会审议通过之日起至 2023 年度报告披露之日内有效，在前述额度和期限范围内，可循环滚动使用，并同意授权公司董事长或总经理在上述有效期及资金额度内签署相关合同及文件。2023 年 5 月 8 日，公司 2022 年度股东大会审议通过上述议案。

## **二、公司 2023 年度证券与衍生品投资情况**

### **（一）证券投资**

公司对报告期内证券投资损益情况进行了确认，报告期内确认公允价值变动损失 183,960.00 元人民币，确认投资损失 158,426.10 元人民币，合计损失 342,386.10 元人民币。

### **（二）衍生品投资**

公司对报告期内期货投资损益情况进行了确认，报告期内确认公允价值变动损失 139,360.51 元人民币，确认投资收益 154,964.54 元人民币，合计投资收益 15,604.03 元人民币。

## **三、证券与衍生品投资业务的风险分析**

### **（一）证券投资业务的风险分析**

1、证券投资事宜受宏观经济形势、财政及货币政策、汇率及资金面等变化的影响较大，该项投资受到市场波动的影响，投资收益具有不确定性；

2、公司将根据经济形势以及金融市场的变化适时适量的介入，因此证券投资的实际收益不可预期；

3、投资产品的赎回、出售及投资收益的实现受到相应产品价格因素影响，需遵守相应交易结算规则及协议约定，相比于货币资金存在着一定的流动性风

险；

4、相关人员的操作风险。

## （二）衍生品投资业务的风险分析

### 1、市场风险

期货市场存在一定系统性风险，同时期货套期保值需要对价格走势做出预判，一旦价格预测发生方向性错误，可能造成期货交易损失。

### 2、资金风险

期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能带来相应的资金风险；在期货价格波动巨大时，公司可能存在未及时补充保证金而被强制平仓带来实际损失的风险。

### 3、权利金损失风险

当标的资产价格向不利方向变化时，公司可选择不行权，造成权利金的损失。

### 4、操作风险

期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成操作不当或操作失败的可能，从而带来相应风险。

### 5、技术风险

由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

### 6、政策风险

由于国家法律、法规、政策变化以及衍生品交易规则的修改等原因，从而导致衍生品市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

## 四、公司采取的风险控制措施

### （一）证券投资业务

为了应对证券投资业务的上述风险，公司采取以下风险控制措施：

1、公司在进行证券投资时，将严格按照《公司章程》《证券投资管理制度》相关规定对证券投资事项进行决策、管理、检查和监督，能够有效控制和防范操作风险；

2、鉴于证券投资仍存在一定的市场风险和投资风险，公司将加强市场分析、调研以及人员培训工作，根据市场环境的变化，及时调整投资策略及规模，严控投资风险；

3、必要时可聘请外部具有丰富投资实战管理经验的人员为公司风险投资提供咨询服务，保证公司在投资前进行严格、科学的论证，为正确决策提供合理建议；

4、公司审计部按照《内部审计制度》相关规定定期对公司证券投资进行监督和检查；

5、公司董事会审计委员会有权随时调查跟踪公司证券投资情况，以此加强对公司证券投资项目的前期与跟踪管理，控制风险；

6、公司监事会有权对公司证券投资情况进行定期或不定期的检查，如发现违规操作情况，可提议召开董事会审议停止公司的证券投资活动；

7、独立董事可以对证券投资资金使用情况进行检查，并有权聘任外部审计机构进行资金的专项审计；

8、公司将依据深圳证券交易所的相关规定，及时履行信息披露义务。

## （二）衍生品投资业务

为了应对衍生品投资业务的上述风险，公司采取以下风险控制措施：

1、制定期货套期保值业务管理制度

公司制定了《期货套期保值业务管理制度》，对期货套期保值业务的审批权限、管理及操作流程、内部风险控制措施等作出了明确规定，能有效规范投资行为，控制投资风险。

## 2、严守套期保值原则

严守套期保值原则，杜绝投机交易。将期货套期保值业务与公司生产、经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

## 3、避免市场流动性风险

公司根据生产需求产生的大宗材料采购计划，选择流动性强、风险可控的期货品种适时开展套期保值等业务。公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

## 4、建立客户信用管理体系

建立客户的信用管理体系，在交易前对交易对方进行资信审查，确定交易对方有能力履行相关合同，慎重选择从事商品期货套期保值业务的交易对手。

## 5、设立专人监控

设专人对持有的期货套期保值业务合约持续监控，设定止损目标，将损失控制在一定的范围内，防止由于市场出现市场性风险、系统性风险等造成严重损失。在市场剧烈波动或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈浮亏时及时报告公司决策层，并积极应对。

## 6、及时关注相关政策

加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。

神宇通信科技股份有限公司

董事会

2024年4月16日